

TRƯỜNG ĐẠI HỌC VĂN LANG
ĐƠN VỊ: KHOA TÀI CHÍNH – NGÂN HÀNG

ĐỀ THI/ĐỀ BÀI, RUBRIC VÀ THANG ĐIỂM
THI KẾT THÚC HỌC PHẦN
Học kỳ 1, năm học 2024-2025

I. Thông tin chung

Tên học phần:	Quản trị rủi ro tài chính		
Mã học phần:	71FINC40043	Số tin chỉ:	03
Mã nhóm lớp học phần:	241_71FINC40043_01,02,03,04		
Hình thức thi: Tiểu luận	Thời gian làm bài:	14	Ngày kể từ ngày thi
☐ Cá nhân	☒ Nhóm		
<i>Quy cách đặt tên file</i>	<i>Tên văn bản tất cả thành viên _241_71FINC40043</i>		

II. Các yêu cầu của đề thi nhằm đáp ứng CLO

Ký hiệu CLO	Nội dung CLO	Hình thức đánh giá	Trọng số CLO trong thành phần đánh giá (%)	Câu hỏi thi số	Điểm số tối đa	Lấy dữ liệu đo lường mức đạt PLO/PI
(1)	(2)	(3)	(4)	(5)	(6)	(7)
CLO1	Liên hệ kiến thức về thị trường, lãi suất, tỷ giá, tín dụng, thanh khoản để nhận diện rủi ro tài chính DN phải đối mặt	Tiểu luận nhóm	20%	Chương 2, 3	2	PLO3 PI3.3
CLO2	Thiết lập các giải pháp để quản trị rủi ro lãi suất, tỷ giá, chú trọng sử dụng công cụ phái sinh.	Tiểu luận nhóm	25%	Chương 2, 3 và 4	2,5	PLO4 PI4.2
CLO3	Xây dựng nhiệm vụ phù hợp cho mỗi thành viên, và sử dụng thành thạo kỹ năng làm việc nhóm để thực hiện công việc chuyên môn	Tiểu luận nhóm	25%	Chương 1, 2, 3 và 4	2,5	PLO6 PI6.1

Ký hiệu CLO	Nội dung CLO	Hình thức đánh giá	Trọng số CLO trong thành phần đánh giá (%)	Câu hỏi thi số	Điểm số tối đa	Lấy dữ liệu đo lường mức đạt PLO/PI
CLO4	Thực hiện khả năng phân biệt để đánh giá và giải quyết thành thực các tình huống mô phỏng quản trị rủi ro tài chính	Tiểu luận nhóm	20%	Chương 3, 4	2	PLO5 PI5.3
CLO5	Thực hiện thói quen tự học và nghiên cứu thêm các tình huống quản trị rủi ro tài chính trên thực tế.	Tiểu luận nhóm	10%	Chương 1, 2, 3 và 4	1	PLO10 PI10.4

III. Nội dung đề bài

1. Đề bài

Mỗi nhóm sinh viên sẽ chọn 1 công ty có mã chứng khoán được niêm yết trên Sở Giao dịch chứng khoán Thành phố Hồ Chí Minh (HOSE). Nhóm sinh viên được yêu cầu thực hiện các công việc như sau:

- ✓ **Yêu cầu 1:** Giới thiệu về công ty
- ✓ **Yêu cầu 2:** Thu thập dữ liệu giá cổ phiếu hàng ngày trong khoảng thời gian tối thiểu 5 năm gần nhất. Giả sử nhóm đầu tư vào cổ phiếu này với số vốn đầu tư được mặc định là 20 tỷ VNĐ. Bằng cách mô phỏng dữ liệu giá lịch sử, hãy tính toán giá trị chịu rủi ro (VaR) 95% hàng ngày của cổ phiếu được lựa chọn, và đưa ra nhận xét.
- ✓ **Yêu cầu 3:** Tính toán giá trị Z-score của công ty được lựa chọn
- ✓ **Yêu cầu 4:** Mỗi nhóm sinh viên nhận dạng các rủi ro (RR) chi tiết quan trọng của công ty, trong đó số lượng rủi ro chi tiết phải đáp ứng số lượng tối thiểu được cho theo bảng sau:

STT	Nhóm rủi ro	Số lượng rủi ro chi tiết
1	Rủi ro vận hành	Tối thiểu 2 rủi ro chi tiết
2	Rủi ro tín dụng	Tối thiểu 1 rủi ro chi tiết
3	Rủi ro thị trường	Tối thiểu 2 rủi ro chi tiết
4	Rủi ro thanh khoản	Tối thiểu 1 rủi ro chi tiết

Lưu ý: nhóm sinh viên phải phân tích từng rủi ro chi tiết gắn kết chặt chẽ với tình hình hoạt động kinh doanh của công ty.

- ✓ **Yêu cầu 5:** Tương ứng với mỗi RR chi tiết được nhận dạng phía trên, nhóm sinh viên đề xuất từng giải pháp phù hợp nhằm hạn chế các rủi ro này.

2. Hướng dẫn thể thức trình bày đề bài

- ✓ **Về hình thức và cách thức nộp bài:** nhóm sinh viên được yêu cầu nộp 2 file như sau

1. File bài tiểu luận được định dạng dưới dạng file Word, Times New Roman cỡ chữ 13, cách dòng 1.15, độ dài nội dung chính của bài tiểu luận tối đa 30 trang (không bao gồm các trang bìa, mục lục, tài liệu tham khảo, phụ lục...).
2. File Excel tính toán chi tiết giá trị VaR 95% và giá trị Z-score của công ty được lựa chọn.

✓ **Cấu trúc bài tiểu luận (file Word) đề xuất:**

+ **Chương 1: Giới thiệu về công ty**

- Tương ứng với yêu cầu 1 của đề bài

+ **Chương 2: Tính toán thông số rủi ro của công ty**

- Tính toán giá trị VaR 95% hàng ngày của cổ phiếu được lựa chọn và đưa ra nhận xét (theo yêu cầu 2 của đề bài).
- Tính toán giá trị Z-score của công ty được lựa chọn (theo yêu cầu 3 của đề bài).

+ **Chương 3: Nhận dạng rủi ro chi tiết của công ty**

- Tương ứng với yêu cầu 4 của đề bài

+ **Chương 4: Các giải pháp hạn chế rủi ro**

- Tương ứng với mỗi rủi ro chi tiết đã được đề cập ở chương 3, nhóm sinh viên đề xuất từng giải pháp phù hợp nhằm hạn chế các rủi ro chi tiết này (theo yêu cầu 5 của đề bài).

- ✓ Nhằm khuyến khích sự sáng tạo, các học viên được tự do thêm các nội dung khác ngoài những yêu cầu nội dung cơ bản.

3. Rubric và thang điểm

Tiêu chí	Trọng số	Kém 0%	Trung bình kém 25%	Trung bình khá 50%	Khá 75%	Tốt 100%
1. Quản lý thời gian	10%	Quá thời gian cho phép				Đúng quy định
2. Cấu trúc	10%	Rất khó theo dõi	Khó theo dõi	Tương đối trực quan	Khá trực quan	Rất trực quan và thẩm mỹ
3. Giới thiệu công ty	10%	Không giới thiệu được	Giới thiệu còn sơ sài	Giới thiệu tương đối đầy đủ nhưng có sai sót quan trọng	Giới thiệu khá đầy đủ nhưng còn sai sót nhỏ	Giới thiệu đầy đủ và chính xác
4. Tính toán giá trị VaR và nhận xét	10%	Không tính toán được	Tính toán chưa đầy đủ và có nhiều chỗ sai sót	Tính toán được đầy đủ, nhưng còn nhiều sai sót và nhận xét có tính hợp lý thấp	Tính toán được đầy đủ, nhưng còn một số sai sót và nhận xét hợp lý	Tính toán được đầy đủ, đảm bảo tính khoa học và nhận xét hợp lý
5. Tính toán giá trị Z-score	10%	Không tính toán được	Tính toán chưa đầy đủ và có nhiều chỗ sai sót	Tính toán được đầy đủ, nhưng còn nhiều sai sót và nhận xét có tính hợp lý thấp	Tính toán được đầy đủ, nhưng còn một số sai sót và nhận xét hợp lý	Tính toán được đầy đủ, đảm bảo tính khoa học và nhận xét hợp lý
6. Nhận dạng nhóm RR vận hành, rủi ro tín dụng	10%	Không nhận dạng được	Nhận dạng sơ sài	Nhận dạng tương đối đầy đủ nhưng tính hợp lý thấp	Nhận dạng khá đầy đủ nhưng còn vài điểm bất hợp lý	Nhận dạng được đầy đủ và tính khoa học cao
7. Nhận dạng nhóm RR thị trường, rủi ro thanh khoản	10%	Không nhận dạng được	Nhận dạng sơ sài	Nhận dạng tương đối đầy đủ nhưng tính hợp lý thấp	Nhận dạng khá đầy đủ nhưng còn vài điểm bất hợp lý	Nhận dạng được đầy đủ và tính khoa học cao

Tiêu chí	Trọng số	Kém 0%	Trung bình kém 25%	Trung bình khá 50%	Khá 75%	Tốt 100%
8. Giải pháp về nhóm RR vận hành, rủi ro tín dụng	10%	Không đưa ra được giải pháp	Giải pháp sơ sài	Giải pháp tương đối đầy đủ nhưng tính hợp lý thấp	Giải pháp khá đầy đủ nhưng còn vài điểm bất hợp lý	Giải pháp đầy đủ và tính khoa học cao
9. Giải pháp về nhóm RR thị trường, rủi ro thanh khoản	10%	Không đưa ra được giải pháp	Giải pháp sơ sài	Giải pháp tương đối đầy đủ nhưng tính hợp lý thấp	Giải pháp khá đầy đủ nhưng còn vài điểm bất hợp lý	Giải pháp đầy đủ và tính khoa học cao
10. Sáng tạo và giải quyết vấn đề	10%	Không sáng tạo	Ít sáng tạo	Sáng tạo ở mức độ trung bình	Sáng tạo ở mức khá	Sáng tạo ở mức tốt

TP. Hồ Chí Minh, ngày 09 tháng 10 năm 2024

Người duyệt đề

Giảng viên ra đề



ThS. Lê Thị Mỹ Duyên

TS. Phạm Tuấn Anh